

Central Daily Market Report

2021年8月2日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2021年8月2日 需給速報	2021年8月3日 需給予想	2021年8月4日 当社予想
銀行券	600	200	0
財政	▲ 15,700	▲ 15,600	▲ 87,000
資金過不足	▲ 15,100	▲ 15,400	▲ 87,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 4,000
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 200		
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
ETF買入			
国債補完供給	▲ 200		200
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 15,500	▲ 15,200	▲ 91,000
当座預金残高	5,373,300	5,358,100	5,267,100
準備預金残高	4,701,700		
積み終了先	4,701,700		
超過準備	4,701,600		
非準備預金先	671,600		
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,747,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			58.06%

●2021年8月2日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.07～▲0.025%の調達で始まった。一巡後は▲0.07～▲0.06%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.085～▲0.075%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

＜短国市場＞

本日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP市場は、入札件数が少なく閑散であった。また、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/8/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.085	0.015	0.000	27,781.02	497.43	109.71-72	109.66-68
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.027				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.048				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.030	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.098						
3M			▲ 0.015				▲ 0.113	▲ 0.103						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	7/26	7/27	7/28	7/29	7/30
									日銀当預残	5,339,800	5,358,300	5,360,300	5,372,300	5,388,800
									準備預金残	4,652,100	4,666,900	4,673,900	4,675,400	4,691,600
									マネタリーベース	6,560,400	6,578,000	6,579,700	6,592,500	6,608,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.039%	▲ 0.041%	▲ 0.043%	▲ 0.044%
									コール市場残高	162,969	160,294	158,443	156,558	159,181
									うち無担	142,328	140,200	137,520	137,024	138,396
									うちO/N	82,472	79,924	76,144	76,278	79,515
									うち有担	20,641	20,094	20,923	19,534	20,785

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/2	2021/8/3	▲ 0.350	164	164		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/2	2021/8/3	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月3日の予定

*7月実績/8月見込み財政資金対民間収支	*米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(26,000億円、8/4発行)
*7月の都区部消費者物価指数(CPI)		*交付税特別会計借入(11,000億円、8/13借入)
市場予想:前年同月比(除く生鮮)0.0%		
*7月のマネタリーベース		

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入